

# 东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金 基金产品资料概要

编制日期：2020年8月26日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

|         |            |                |            |
|---------|------------|----------------|------------|
| 基金简称    | 东吴安鑫量化混合   | 基金代码           | 002561     |
| 基金管理人   | 东吴基金管理有限公司 | 基金托管人          | 江苏银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2016-06-03 | 上市交易所及上市日期     | 暂未上市       |
| 基金类型    | 混合型        | 交易币种           | 人民币        |
| 运作方式    | 开放式        | 开放频率           | 每个开放日      |
| 基金经理    | 周健         | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020-07-23 |
| 其他      |            | 证券从业日期         | 2006-08-01 |

## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》第九章了解详细情况

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金采用量化策略进行选股和择时，控制风险，追求持续的资产增值。   |
| 投资范围   | 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括但不限于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。<br>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。<br>基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的0%-95%，投资于债券等固定收益类资产比例不低于基金资产的5%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 |
| 主要投资策略 | 本基金采用以股票投资为主，固定收益类资产管理为辅的投资策略。本基金一方面引入量化择时策略，进行股票组合投资的建仓、平仓和止盈止损，另一方面通过多因子量化模型选择优势股票组合，以期给投资者带来稳定收益。<br>(一) 择时策略   |

本基金通过对中证 800 指数样本股从市场广度分析、成交量分析和动量分析三个维度进行趋势的量化跟踪分析，以此确定交易时机。根据均线系统策略、相对强弱模型等形成具客观性、一致性的量化交易规则，严格执行开平仓、止盈止损、平仓后再入场等操作。

(二) 组合配置策略

1、行业组合

利用择时策略确定操作时点后，采用多因子模型优选技术和基本面因子排名居前的子行业（参照申万二级行业划分标准）进行配置。

2、替代成份股

(三) 资产支持证券投资策略

(四) 股指期货投资策略

(五) 权证投资策略

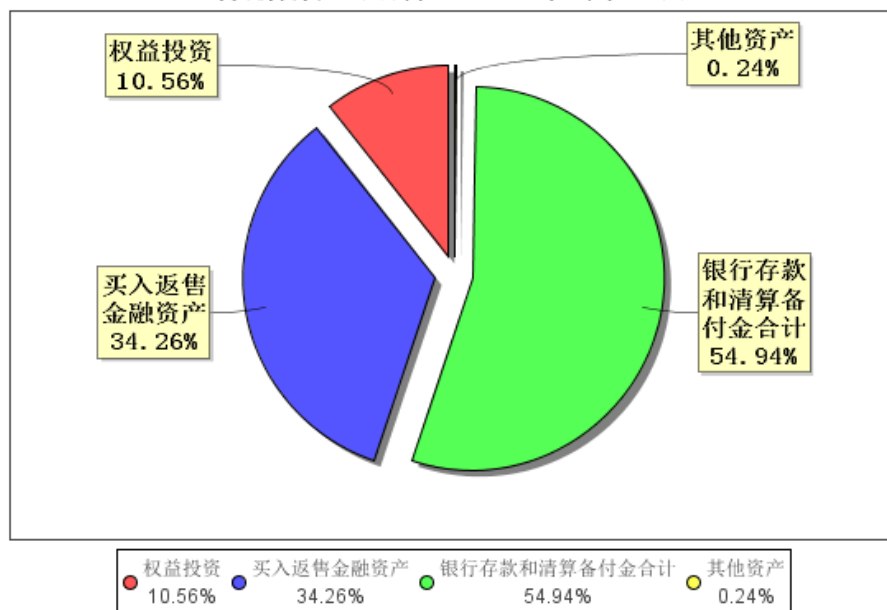
(六) 固定收益类资产投资策略

**业绩比较基准** 65%×中证 800 指数收益率+35%×中国债券综合全价（总值）指数收益率

**风险收益特征** 本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

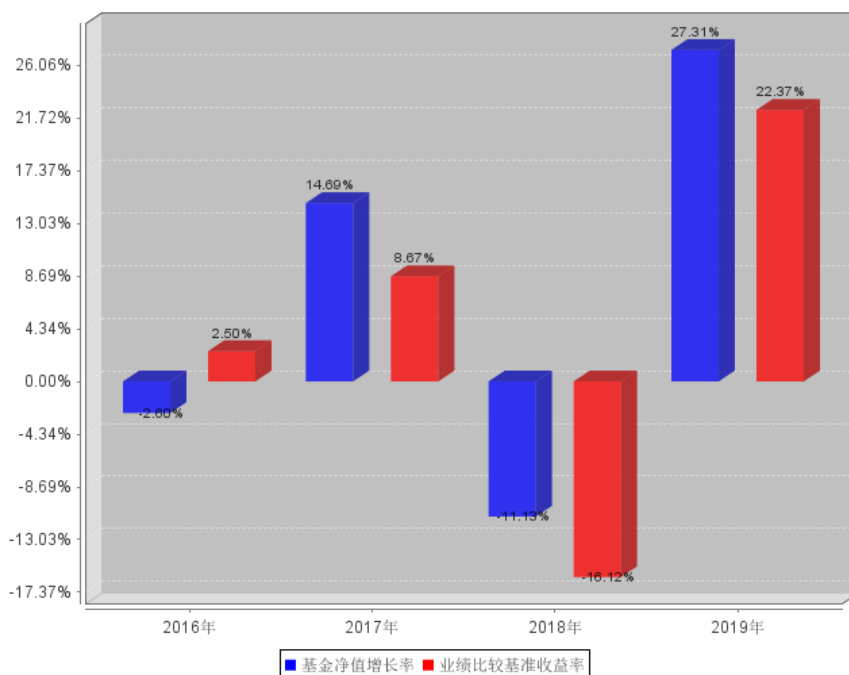
(二) 投资组合资产配置图表

投资组合资产配置图表  
数据截止日期：2020年6月30日



(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

| 费用类型      | 金额 (M) / 持有期限 (N)  | 收费方式/费率  | 备注 |
|-----------|--------------------|----------|----|
| 申购费 (前收费) | M < 100 万          | 1.50%    |    |
|           | 100 万 ≤ M < 200 万  | 1.20%    |    |
|           | 200 万 ≤ M < 500 万  | 0.80%    |    |
|           | 500 万 ≤ M < 1000 万 | 0.30%    |    |
|           | M ≥ 1000 万         | 1000 元/笔 |    |
| 赎回费       | N < 7 天            | 1.50%    |    |
|           | 7 天 ≤ N < 30 天     | 0.75%    |    |
|           | 30 天 ≤ N < 1 年     | 0.50%    |    |
|           | 1 年 ≤ N < 2 年      | 0.25%    |    |
|           | N ≥ 2 年            | 0.00%    |    |

#### (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率                 |
|------|--------------------------|
| 管理费  | 0.80%                    |
| 托管费  | 0.25%                    |
| 其他费用 | 费用的计算方法及支付方式详见招募说明书及相关公告 |

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

## 四、风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

#### 1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险。

#### 2、管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。

3、职业道德风险：是指公司员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为而可能导致的损失。

#### 4、流动性风险

本基金属于开放式基金，基金份额可以在基金合同约定的时间和场所进行申购和赎回，因此会面临一定的流动性风险。所谓流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形，从而导致基金仓位调整的困难，引发流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### 5、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

6、投资管理风险：(1) 本基金是一只混合型基金，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金；(2) 选股方法、选股模型风险；(3) 基金经理主观判断错误的风险；(4) 其他风险。

#### 7、投资股指期货的风险

本基金参与股指期货交易。股指期货交易采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股指期货标的指数微小的变动就可能使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。此外，交易所对股指期货的交易限制与规定会对基金投资股指期货的策略执行产生影响，从而对基金收益产生不利影响。

### (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)][客服电话:400-821-0588]

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料